

For immediate release

Contact:広報部 成松 恭多/戸塚 真理奈
+81 3 4530 5623

本稿は、バークレイズ・グループの英文リリースの日本語訳です。その正確な内容につきましては、原文である英文リリースをご参照ください。本稿と原文において齟齬がある場合には原文が優先します。リリース原文は <http://www.barclays.co.jp/> の「News」欄にてご覧いただけます。

バークレイズ、 債券ベンチマーク・インデックスの組入れルールを変更

【2012年11月5日、ニューヨーク（和文配信11月6日）】 世界有数の債券市場ベンチマークを提供するバークレイズは、10月に実施した年次の定期的なインデックス見直し作業と運営管理プロセスを受け、本日、インデックス組入れルール見直しを発表しました。今回の見直しに伴い2013年3月31日からいくつかの組入れルールが変更される一方、その他既存ルールは従来通りとすることが再確認されました。

こうした変更は、変貌しつつある債券市場の現状を注意深く考察するとともに、バークレイズ・インデックスをポートフォリオのベンチマークや、広範な債券市場のリターン計測の手段としてご利用いただく世界中の投資家の皆様のご意見を考慮した上で決定されたものです。

2013年3月31日から実施されるインデックス組入れルール変更は以下の通りです。

新興市場インデックス

- バークレイズの主要な外貨建て新興市場ベンチマーク債券インデックスは、新興市場投資ユニバースにおいて社債や政府関連債の割合が増加していることを受け、広範な対象国・セクターを含むことを明確にするため、新興市場(EM)総合ベンチマーク債券インデックスと改称されます。
- バークレイズの全ての新興市場ベンチマーク債券インデックス(外貨建て、自国通貨建て、物価連動債)は、インデックス適格性を決定する際に、共通の新興国リストを用います。新興国リストは世界銀行および国際通貨基金の定義に基づいて作成されますが、それ以外にも一般に投資家が新興国とみなしているいくつかの国(韓国、イスラエル、台湾、チェコ)が含まれます。
- バークレイズの主要な自国通貨建て新興市場政府債インデックスに、対象国としてナイジェリアとルーマニアが追加されます。

ハイ・イールド・インデックス

- 新興国定義の変更は、インデックス・ルール上、新興国発行体を除外しているバークレイズ・ハイ・イールド社債インデックスにも反映されます。新興国発行体による米ドル、ユーロ、英ポンド建てのハイ・イールド債券は、バークレイズの米国ハイ・イールド・インデックスおよび汎欧州ハイ・イールド・インデックスから除外されます。

米国ABSインデックス/米国総合インデックス

- 全てのインデックス適格ルールを満たした場合、自動車リース・ローン、自動車フロアプラン・ローン、米国外の資産(キャッシュフローが米ドル建てであるもの)を担保とする資産担保債(ABS)はバークレイズの固定利付および変動利付米国ABSインデックスに含まれます。

グローバル総合インデックス

- ローン・パーティシペーション・ノート(LPN)がグローバル総合インデックス、汎欧州総合インデックスなどバークレイズの総合インデックスに加えられます。

For immediate release

Contact:広報部 成松 恭多/戸塚 真理奈
+81 3 4530 5623

- バークレイズのいずれかのインデックスに含まれる全ての債券市場について、最低発行額基準金額を現地通貨毎に個別に設定します。この変更は、グローバル総合インデックス、自国通貨建て新興市場政府債インデックスの両方に適用されます。上記新基準が適用される時点まで、米ドル、ユーロ、日本円の基準金額に換算して設定されている現在の通貨別最低発行額基準は有効です。

物価連動債インデックス

- 世界物価連動国債 (WGILB) インデックスへの新しい市場の追加に関しては、(1) 新たに物価連動債を発行しはじめたり、休眠状態の物価連動債を再開したりする先進国については四半期毎、(2) 新興国については年1回の頻度で見直しをおこないます。従来、世界物価連動国債インデックスの対象国見直しは年1回、12月31日に実施していました。主要なインデックスに組入れられるためには、引き続き、最低市場サイズ、格付け、投資可能性などの基準を満たす必要があります。
- 40億米ドル以上の最低市場サイズ基準を満たした段階で、デンマークとニュージーランドの物価連動国債は世界物価連動国債インデックスとグローバル物価連動債 (シリーズL) インデックスの両方に組入れられます。

各変更の詳細についてはBarclays Liveから入手可能です。

バークレイズについて

バークレイズは世界で事業を展開し、お客様に貸付、投資、資産保護のサービスを提供しています。バンキング事業では 300 年以上の歴史と卓越した専門性を有しており、世界 50 カ国以上で展開し、約 140,000 人の従業員を擁しています。

バークレイズは世界の大手事業法人、政府、金融機関のお客様にニーズに応じた戦略的アドバイス、資金調達およびリスク管理に関するフルレンジのサービスを提供しています。お客様にはバークレイズ・グループ全体に幅広くわたる、金融に関する専門性をお届けしています。また、世界最大規模の金融サービス機関として、リテール・バンキング、クレジットカード、コーポレート・バンキング、ウェルスおよびインベストメント・マネジメントの事業も展開しています。バークレイズ・グループは、バークレイズ・バンク・ピーエルシーを通じ、世界トップクラスの投資銀行サービスと金融商品をお客様に提供しています。

##